

GILLES DE TRUCHIS

Maître de Conférences

@ gilles.detruchis@univ-orléans.fr +33 (0)2 38 49 25 17 FDEG, LEO
Rue de Blois, 45067 Orléans, Cedex 2 www.varennes-ecofin.com/
ideas.repec.org/f/pde653.html Updated on October 29, 2024



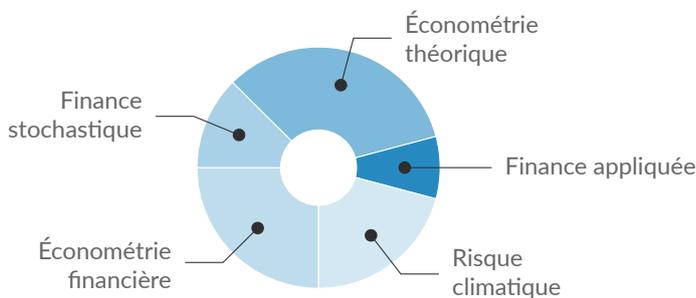
SITUATION ACTUELLE

Maître de Conférences en Économie

Laboratoire d'Économie d'Orléans (LEO)

Sept 2021 – en cours Université d'Orléans, France

DOMAINES DE RECHERCHE



Noncausal Models Forecasting Unbalanced Regression
Long Memory Cointegration Limit Theory
Fractional Integral Semiparametric Methods
Realized Volatility

PUBLICATIONS

Articles publiés

- Karine Constant et al. "The European renewable energy sector in calm and turmoil periods: The key role of sovereign risk". In: *The Energy Journal* (forthcoming) (2024), (CNRS 1, HCERES A).
- Gilles de Truchis and Elena Dumitrescu. "Assessing Volatility Persistence in Fractional Heston Models with Self-exciting Jumps". In: *Econometric Reviews* (forthcoming) (2024), (CNRS 2, HCERES A).
- G. de Truchis, C. Dell'Eva, and B. Keddad. "On exchange rate comovements: New evidence from a Taylor rule fundamentals model with adaptive learning". In: *Journal of International Financial Markets, Institutions and Money* 48 (2017), 82–98 (CNRS 3, HCERES B).
- M. Aloy and G. de Truchis. "Optimal estimation strategies for bivariate fractional cointegration systems and the co-persistence analysis of stock market realized volatilities". In: *Computational Economics* 48.1 (2016), 83–104 (CNRS 3, HCERES B).
- G. de Truchis and B. Keddad. "Long-run comovements in East Asian stock market volatility". In: *Open Economies Review* 27.5 (2016), 969–986 (CNRS 3, HCERES B).
- G. de Truchis and B. Keddad. "On the risk comovements between the crude oil market and US dollar exchange rates". In: *Economic Modelling* 52 (2016), 206–215 (CNRS 2, HCERES A).
- G. de Truchis. "Approximate Whittle analysis of fractional cointegration and the stock market synchronization issue". In: *Economic Modelling* 34 (2013), 98–105 (CNRS 2, HCERES A).

PARCOURS

MCF à EconomiX (UMR 7235)

2015 – 2021 Université Paris Nanterre

ATER

2014 – 2015 Université de Cergy

ATER

2013 – 2014 Aix-Marseille Université

Contrat doctoral (bourse ED 372)

2010 – 2013 Aix-Marseille Université

Doctorat en Économie

2010 – 2014 Aix-Marseille Université

Titre : Fractional Cointegration Analysis of Comovements in Inter. Financial Markets

Directeurs : M. Aloy et G. Dufrénot

RÉALISATIONS

Obtention de la PEDR (2018-2022)
Université Paris Nanterre

Thé des économètres (créé en 2016)
www.varennes-ecofin.com/cje.html

Prix de thèse 2014
Aix-Marseille Université (AMU)

- G. de Truchis and B. Keddad. "Southeast Asian monetary integration: New evidences from fractional cointegration of real exchange rates". In: *Journal of International Financial Markets, Institutions and Money* 26 (2013), 394–412 (CNRS 3, HECERES B).

Chapitres d'ouvrage

- M. Aloy et al. "Shift-volatility transmission in east asian equity markets: New indicators". In: *Market microstructure and nonlinear dynamics*. Springer, 2014, pp. 273–291.

TRAVAUX EN COURS

Documents de travail

- G. de Truchis, S. Fries, and A. Thomas. "Forecasting extreme trajectories using semi-norm representations". 2024.
- G. de Truchis et al. "Speculative Bubbles and optimal portfolio allocation". 2024.
- G. de Truchis, E. Dumitrescu, and S. Tokpavi. "Testing for extreme volatility transmission with realized volatility measures". 2021.
- G. de Truchis and B. Sévi. "Jumps and the normality of oil futures returns". 2021.
- G. de Truchis, F. Dubois, and E. Dumitrescu. "Local Whittle analysis of stationary unbalanced fractional cointegration Systems". 2020.
- G. de Truchis and E. Dumitrescu. "Narrow-band weighted nonlinear least squares estimation of unbalanced cointegration Systems". 2020.

Documents en cours

- D. Banulescu-Radu, G. de Truchis, and Dumitrescu E. *Semiparametric p -components models for volatility and trading volume*. 2021.
- G. de Truchis and E. Dumitrescu. *Unbalanced predictive regressions*. Ongoing paper. 2020.
- G. de Truchis and B. Sévi. *On the efficiency of the CME-NYMEX oil option market: Evidence from a cofractional analysis*. Preliminary version. 2020.

CONTRATS DE RECHERCHE

Analyse Multivariée du Risque Financier et Modélisation de la persistance en présence de Jumps

 2017 - 2018

 Coordinateur avec E. Dumitrescu

 Défi "INFLniTi", CNRS

€6000

Analyse du Risque Financier et Modélisation de la persistance en présence de Jumps

 2016 - 2017

 Coordinateur avec E. Dumitrescu

 Défi "INFLniTi", CNRS

€6000

ORGANISATION DE CONFÉRENCES

International Symposium on Noncausal Econometrics

 2025

 A. Thomas, E. Dumitrescu

 LEDa, LEO

26th Spring Meeting of Young Economists (SMYE 2022)

 19-05-2022

 D. Banulescu-Radu, T. Nunez-Rocha, A. Paris

 LEO

Seminar in Finance & Assurance at Institut Louis Bachelier

 28-05-2019

 E. Dumitrescu, C. Francq, J.M. Zakoian, J. Rombouts

 CREST, ESSEC & EconomiX

Workshop in Financial Econometrics

 21-03-2019

 E. Dumitrescu, O. Darné, Z. Moussa, B. Sévi

 Université de Nantes

Workshop Econometric Theory and Time Series Analysis

 19-09-2018

 D. Banulescu-Radu et E. Dumitrescu

 Hôtel de Lauzun, IEA de Paris

Journée d'Économétrie Appliquée à la Finance

 since 2017 - (annuel)

 V. Mignon et E. Dumitrescu

 Université Paris Nanterre

Thé des Jeunes Économètres

 since 2016 - (mensuel)

 D. Banulescu-Radu et E. Dumitrescu

 Paris & Orléans

CONFÉRENCES

Quantitative Finance and Financial Econometrics

📅 2024, 2022, 2020 (cancelled), 2019, 2018

📍 Aix-Marseille School of Economics (AMSE) - AMU

Workshop ANR MLEforRisk

📅 2024

📍 Université d'Orléans (LEO)

Nonstationarity, Cyclostationarity and Applications

📅 2023

📍 Université de Nanterre (MODAL'X)

Workshop en Économétrie Appliquée

📅 2021

📍 Audencia Business School & Université de Nantes

International Conference of the French Finance Association (AFFI)

📅 2021

📍 Audencia Business School & Université de Nantes

French Econometrics Conference

📅 2019, 2018, 2016, 2015

📍 AMSE, PSE, ESSEC, Université d'Orléans

Congrès de l'AFSE

📅 2019

📍 Université d'Orléans

Workshop ANR Multirisk

📅 2019

📍 Villa Finaly, Université Paris Dauphine (sur invitation)

Financial Time Series Workshop

📅 2018

📍 CREST - ENSAE (sur invitation)

INFINITI Conference

📅 2016, 2015, 2014

📍 Trinity College Dublin, University of Ljubljana, Monash University

ISCE Conference

📅 2016, 2014

📍 Université d'Evry, INSEEC

3rd JEAM Conference

📅 2015

📍 Université Paris 13

International Workshop in FMND

📅 2015, 2013

📍 Université d'Evry, ESSCA

ISEFI Conference

📅 2015

📍 IPAG Business School

ADRES

📅 2015

📍 Université Panthéon-Sorbonne

Financial Management Conference

📅 2014

📍 IPAG Business School

Journée d'Économétrie

📅 2014, 2013, 2012

📍 Université Paris Nanterre

SÉMINAIRES

Research Seminar of LERN

📅 2024

📍 Université de Rouen

Finance Seminar of CREST

📅 2020

📍 CREST - ENSAE

Finance Seminar of LEMNA

📅 2020

📍 Université de Nantes

Cournot Seminar of BETA

📅 2020

📍 Université de Strasbourg

Statistics and Econometrics Seminar

📅 2018

Seminar of LEO

📍 AMSE - AMU

📅 2015

Seminar of THEMA

📍 Université d'Orléans

📅 2014

📍 Université de Cergy-Pontoise

ACTIVITÉS DE RÉFÉRÉ

Applied Economics / Computational Economics / Economic Modelling / Energy Economics / International Economics / International Journal of Forecasting / Macroeconomic Dynamics / Revue Économique / Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics / Quantitative Finance

ENSEIGNEMENTS

Advanced Financial Econometrics (Université d'Orléans)	📅 2022 - en cours	🎓 Master 2 ESA	📄 12HCM	👥 35
Econométrie des Données de Survie (Université d'Orléans)	📅 2021 - en cours	🎓 Master 2 ESA	📄 24HCM	👥 35
Statistiques Non-paramétriques (Université d'Orléans)	📅 2021 - en cours	🎓 Master 2 ESA	📄 12HCM	👥 35
Économétrie des Séries Temporelles Multivariées (Université d'Orléans)	📅 2021 - en cours	🎓 Master 1 ESA	📄 30HCM	👥 35
Économétrie des Séries Temporelles Univariées (Université d'Orléans)	📅 2021 - en cours	🎓 Master 1 ESA	📄 30HCM	👥 35
Introduction à l'Économétrie Noncausal (Université Paris Nanterre)	📅 2018 - en cours	🎓 Cours doctoral - ED 396	📄 4HCM	👥 10
Introduction à la Théorie du Bootstrap (Université Paris Nanterre)	📅 2018 - en cours	🎓 Cours doctoral - ED 396	📄 2HCM	👥 10
Économétrie Avancée sous MATLAB (Université Paris Nanterre)	📅 2019 - 2021	🎓 Cours doctoral - ED 396	📄 4HCM	👥 10
Économétrie Financière (Université Paris Nanterre)	📅 2020 - 2021	🎓 Master 2 EIPMC - GDA	📄 24HCM	👥 35
Économétrie Non-Stationnaire (Université Paris Nanterre)	📅 2017 - 2021	🎓 Master 2 EIPMC	📄 21HCM	👥 20
Économétrie Non-linéaire (Université Paris Nanterre)	📅 2016 - 2021	🎓 Master 2 GDA	📄 21HCM	👥 25
Économétrie Spatiale (Université Paris Nanterre)	📅 2015 - 2019	🎓 Master 2 APE	📄 21HCM	👥 20
Méthodes et Instruments de la Finance (Université Paris Nanterre)	📅 2015 - 2021	🎓 Master 1 MBFA (🔄 2019)	📄 24HCM	👥 80
Ateliers d'économétrie (Université Paris Nanterre)	📅 2015 - 2019	🎓 Master 1 MBFA	📄 24HTD	👥 20
Macroéconomie Ouverte (Université Paris Nanterre)	📅 2015 - 2021	🎓 Licence 2 Éco - Gestion	📄 36HCM	👥 250 × 3
Macroéconomie Ouverte (Université Paris Nanterre)	📅 2015 - 2017	🎓 Licence 2 Éco - Gestion	📄 16HTD	👥 35
Macroéconomie (Université de Cergy-Pontoise)	📅 2014 - 2015	🎓 Licence 1 Éco & DU & CMI	📄 128HCM	👥 500
Macroéconomie (Aix-Marseille Université)	📅 2011 - 2014	🎓 Licence 2 Éco	📄 192HTD	👥 30
Économétrie sous SAS (Aix-Marseille Université)	📅 2011 - 2012	🎓 Master Éco et Finance	📄 24HTD	👥 25

Heures équivalent TD enseignées par année (hors charges pour fonction)

📅	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
HTD	160	197	207	219	227	195	204	200	238	220

IMPLICATIONS PÉDAGOGIQUES

Co-Responsable du Master Econométrie et Statistique Appliquée (ESA, Université d'Orléans)

📅 2022 - en cours

🎓 ESA

📍 Parcours FI (M1 + M2) 🧑 40 + 40

Responsable du Master 2 Gestion des Actifs (GDA, Université Paris Nanterre)

📅 2016 - 2021

🎓 GDA - OMERR

📍 Parcours FI & FA 🧑 25 + 20

Création et animation d'un module de préparation au job market (Université Paris Nanterre)

📅 2019 - en cours

🎓 Cours doctoral - ED 396

📍 10HCM

🧑 15

Groupe de travail LMD4 : création et refonte de maquettes (Université Paris Nanterre)

📅 2019 - 2020

🎓 Mention MBFA (M1 & M2)

📍 Maquettes FI & FA (9 parcours)

Participation à des jurys de Validation d'Acquis de l'Expérience (Université Paris Nanterre)

📅 2017 - 2021

🎓 Master 2 GDA

📍 5 jurys VAE

RESPONSABILITÉS COLLECTIVES

Co-organisateur du séminaire du LEO (Université d'Orléans)

📅 2022 - en cours

🎓 LEO

Membre du conseil d'UFR (Université d'Orléans)

📅 2024 - en cours

🎓 UFR DEMO

Membre du conseil de laboratoire (Université d'Orléans)

📅 2022 - en cours

🎓 LEO

Membre du CNU (nommé, suppléant, participation à 3 sessions de promotions)

📅 2016 - 2019

🎓 Conseil National des Universités

Vice-président du CCD (Université Paris Nanterre)

📅 2016 - Juil 2021

🎓 Comité Consultatif de Discipline

Membre du conseil de laboratoire (Université Paris Nanterre)

📅 2016 - Mars 2020

🎓 Laboratoire EconomiX

Membre du conseil de département (Université Paris Nanterre)

📅 2016 - Mars 2019

🎓 UFR SEGMI

ENCADREMENTS

Co-direction de la thèse d'Elhadji Mamadou Guene (avec Christophe Hurlin)

[Prédictions et incertitude statistique dans les méthodes de machine learning appliquées aux séries temporelles](#)

📅 Sept 2024 - en cours

📍 Contrat doctoral

📍 Université d'Orléans

Co-direction de la thèse d'Axel Ehouman (avec Cécile Couharde)

[Le rôle des fluctuations du prix du pétrole dans l'instabilité financière mondiale](#)

📅 Sept 2017 - Dec 2020

📍 Contrat doctoral

📍 Université Paris Nanterre

Suivi de projets entreprises (Université d'Orléans)

📅 2022 - en cours

🎓 Master ESA

🧑 20 à 30 étudiants par an

Soutenances de Mémoire (Université d'Orléans)

📅 2022 - en cours

🎓 Master ESA

🧑 5 à 7 soutenances par an

Suivi d'étudiants en apprentissages (Université Paris Nanterre)

📅 2017 - 2021

🎓 L3 pro e-assurance

🧑 5 à 7 étudiants

Soutenances de Mémoire (Université Paris Nanterre)

COMITÉS MCF

Comité de sélection à l'AMSE

📅 2022, 2024

📍 Aix-Marseille Université

Comité de sélection du CREAM

📅 2018

📍 Université de Rouen

Comité de sélection du LEO

📅 2018

📍 Université d'Orléans

Comité de sélection d'EconomiX

📅 2017, 2020

📍 UPN

CONSULTING

Consultant pour le Ministère des Armées

Missions coordonnées par le Cercle des Économistes

📅 2017-2019

📍 Ministère des Armées

Conférence : Les industries de défense, un atout pour l'économie ?

Organisée par le Cercle des Économistes (J-H Lorenzi) & la Chaire Économie de Défense

📅 22-03-2017

👥 P. de Villiers (Chef d'Etat Major), E. Letta (Premier Ministre Italien), P. Aghion, J-Y. Le Drian

LOGICIELS

MATLAB

Python

R-project

Mathematica

TM Eikon

OxMetrics

STATA

SAS

LaTeX

NOTICE

- 👥 Effectifs étudiants
- 📍 Universités et autres lieux
- 👥 Co-auteurs et coorganisateur
- 🎓 Formations, labos et instances
- 📄 Charges horaires et autres infos
- 🏛️ Institution source d'un financement
- Ⓜ️ Cours dédoublé en FA depuis 20xx